



东兴期货
DONGXING FUTURES

期货晨报

期货研究报告

2019年9月24日

投资咨询部

一、隔夜基差表

东兴期货 投资咨询部 DONGXING FUTURES		隔夜基差表						
日期	品种	现货	合约	合约价格	隔夜涨跌幅	期货升贴水	升贴水变化	注:
2019/09/23	IF	3890.7	IF1910	3894.8	-0.79%	4.14	升水扩大	现货价格: 沪深300指数
			IF1911	3889.4	-	-1.26	贴水缩窄	
2019/09/23	IC	5171.5	IC1910	5139.4	-0.16%	-32.08	贴水扩大	现货价格: 中证500指数
			IC1911	5099.4	-	-72.08	贴水扩大	
2019/09/23	IH	2930.9	IH1910	2930.8	-1.03%	-0.11	贴水扩大	现货价格: 上证50指数
			IH1911	2929.6	-	-1.31	贴水缩窄	
2019/09/23	TS	2.7031	TS1912	100.29	0.00%	-	-	现货: 中债到期收益率(2年)
			TS2003	100.16	0.01%	-	-	
2019/09/23	TF	2.9841	TF1912	99.87	-0.03%	-	-	现货: 中债到期收益率(5年)
			TF2003	99.66	0.02%	-	-	
2019/09/23	T	3.1005	T1912	98.475	-0.06%	-	-	现货: 中债到期收益率(10年)
			T2003	98.145	-0.04%	-	-	
2019/09/23	铁矿	808.87	I2001	647.5	1.97%	-161.37	贴水扩大	现货价格: 进口铁矿石:62%品位:干基粉矿含税价
			I2005	571	2.06%	-237.87	贴水扩大	
2019/09/23	螺纹	3866	RB1910	3774	2.25%	-91.98	贴水缩窄	现货价格: 螺纹钢:HRB400 20mm:上海, 扣除理计价格
			RB2001	3510	3.60%	-355.98	贴水缩窄	
2019/09/23	LLDPE	7700	L2001	7630	-0.13%	-70.00	贴水缩窄	完税自提价(低端价): 线型低密度聚乙烯LLDPE(膜级): 上海
			L2005	7415	0.47%	-285.00	贴水缩窄	
2019/09/23	PP	8830	PP2001	8261	0.49%	-569.00	贴水缩窄	市场价(现货基准价): PP粒(T30S): 余姚
			PP2005	7876	0.19%	-954.00	贴水缩窄	
2019/09/23	棕榈油	4700	P2001	4814	0.50%	114.00	升水扩大	交货价: 棕榈油: 天津港/宁波港/黄埔港扣除升贴水后最低价
			P2005	5070	0.44%	370.00	升水扩大	
2019/09/23	焦煤	1710	JM2001	1300	0.31%	-410.00	贴水缩窄	京唐港: 库提价(含税): 主焦煤(A10%, V24%, <0.8%S, G80): 河北产
			JM2005	1231	1.15%	-479.00	贴水缩窄	
2019/09/23	焦炭	2145	J2001	1982	2.22%	-163.16	贴水缩窄	天津港: 平仓价(含税): 一级冶金焦 (A<12.5%, <0.65%S, CSR>65%, Mt8%): 山西产, 水分折算后
			J2005	1882	1.89%	-263.16	贴水缩窄	
2019/09/23	动力煤	585	ZC001	573	-0.59%	-12.00	贴水扩大	市场价: 动力煤(Q5500, 山西产): 秦皇岛
			ZC005	562.6	-0.35%	-22.40	贴水扩大	
2019/09/23	PTA	5080	TA001	5176	0.66%	96.00	升水缩窄	PTA: CCFEI价格指数: 精对苯二甲酸PTA内盘
			TA005	5134	0.16%	54.00	升水缩窄	
2019/09/23	MA	2235	MA001	2377	2.63%	142.00	升水扩大	MA: 市场估价(中间价): 甲醇: 江苏出罐
			MA005	2303	1.63%	68.00	升水缩窄	
2019/09/23	橡胶	11150	RU1910	11030	0.18%	-120.00	贴水扩大	市场价: 天然橡胶: 云南国营全乳胶(SCR5): 上海
			RU2001	12000	1.10%	850.00	升水缩窄	
2019/09/23	豆油	5850	Y2001	6068	0.56%	218.00	升水扩大	现货价: 四级豆油: 大连
			Y2005	6078	0.43%	228.00	升水扩大	
2019/09/23	豆粕	3070	M2001	2862	-0.03%	-208.00	贴水扩大	现货价: 豆粕: 大连
			M2001	2862	-0.03%	-208.00	贴水扩大	
2019/09/23	菜油	7630	OI001	7381	0.89%	-249.00	贴水缩窄	现货价: 菜油: 安徽
			OI005	7340	0.60%	-290.00	贴水缩窄	
2019/09/23	菜粕	2375	RM001	2272	0.22%	-103.00	贴水缩窄	现货价: 平均价: 菜粕
			RM005	2301	0.09%	-74.00	贴水缩窄	

免责声明: 我公司对本表中信息和数据的准确性及完整性不作任何保证。在任何情况下, 表格中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。

二、各品种基本面指标

 东兴期货 DONGXING FUTURES 投资咨询部 2019/9/24		宏观基本面指标变化		
资金变动		隔夜	前一日	变化幅度
	两市融资余额（亿元）	9712.7600	9737.6400	-24.8800
	沪股通净流入（亿元）	-22.1099	71.3707	-93.4806
	深股通净流入（亿元）	6.7964	77.2527	-70.4563
宏观流动性	银行间质押式回购（1天）	2.8312	2.8588	-0.0276
	银行间质押式回购（7天）	2.9008	3.0274	-0.1266
	Shibor（1天）	2.7590	2.7460	0.0130
	Shibor（7天）	2.7320	2.7310	0.0010
二级市场流动性	沪市质押式回购	2.8050	2.8450	-0.0400
	深市质押式回购	2.5000	2.8700	-0.3700
期指操作建议	北向资金净流出，盘整行情下，谨慎者期指多单暂避。			
备注：两融余额由于更新时间影响，采用前日数据代替隔夜数据。				

免责声明：本报告中的信息均来源于已公开的资料，我公司对这些信息的准确性及完整性不作任何保证，不保证该信息未经任何更新，也不保证本公司做出的任何建议不会发生任何变更。在任何情况下，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价。本报告版权归东兴期货投资咨询部所有。未获得东兴期货投资咨询部书面授权，任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。如引用、刊发，需注明出处为“东兴期货投资咨询部”，且不得对本报告进行有悖原意的删节和修改。